

**华夏中证 500 交易型开放式指数  
证券投资基金联接基金  
2022 年中期报告  
2022 年 6 月 30 日**

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
§4 管理人报告.....	7
§5 托管人报告.....	12
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	36
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	37
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	49
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	50
7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	50
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	50
7.11 本基金投资股指期货的投资政策.....	50
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.13 投资组合报告附注.....	50
§8 基金份额持有人信息.....	51
§9 开放式基金份额变动.....	52
§10 重大事件揭示.....	52
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§12 备查文件目录.....	54

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
基金简称	华夏中证 500ETF 联接	
基金主代码	001052	
交易代码	001052	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 5 月 5 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,428,645,167.04 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏中证 500ETF 联接 A	华夏中证 500ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	001052	006382
报告期末下属分级基金的份额总额	3,272,641,237.36 份	156,003,929.68 份

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	512500
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 5 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015 年 5 月 29 日
基金管理人名称	华夏基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过对目标 ETF 基金份额的投资，追求跟踪标的指数，获得与指数收益相似的回报。
投资策略	本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标 ETF。基金也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。为了更好地实现投资目标，基金还将投资于股指期货和其他经中国证监会允许的衍生工具，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的衍生工具。本基金还将积极参与风险低且可控的债券回购等投资，以及国债期货投资。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率 ×95% + 人民币活期存款税后利率 ×5%。
风险收益特征	本基金为目标 ETF 的联接基金，目标 ETF 为股票型指数基金，因此本基金的风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

#### 2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	主要投资策略包括组合复制策略、替代性策略、存托凭证投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略等。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为“中证 500 指数”。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	李申
	联系电话	400-818-6666	021-60637102
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-6666	021-60637111
传真		010-63136700	021-60635778
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区金融大街25号
办公地址		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		100033	100033
法定代表人		杨明辉	田国立

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）	
	华夏中证 500ETF 联接 A	华夏中证 500ETF 联接 C
本期已实现收益	20,353,978.18	1,121,261.57

本期利润	-259,407,744.64	-21,776,031.41
加权平均基金份额本期利润	-0.0814	-0.1080
本期加权平均净值利润率	-11.27%	-14.94%
本期基金份额净值增长率	-10.47%	-10.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	华夏中证 500ETF 联接 A	华夏中证 500ETF 联接 C
期末可供分配利润	-848,078,706.80	-66,353,545.70
期末可供分配基金份额利润	-0.2591	-0.4253
期末基金资产净值	2,424,562,530.56	113,904,521.52
期末基金份额净值	0.7409	0.7301
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	华夏中证 500ETF 联接 A	华夏中证 500ETF 联接 C
基金份额累计净值增长率	-25.91%	40.40%

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 华夏中证 500ETF 联接 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.72%	1.05%	6.74%	1.05%	0.98%	0.00%
过去三个月	3.30%	1.65%	1.99%	1.66%	1.31%	-0.01%
过去六个月	-10.47%	1.54%	-11.65%	1.55%	1.18%	-0.01%
过去一年	-3.33%	1.25%	-4.83%	1.26%	1.50%	-0.01%
过去三年	35.70%	1.28%	29.13%	1.28%	6.57%	0.00%
自基金合同生效起至今	-25.91%	1.57%	-22.05%	1.62%	-3.86%	-0.05%

##### 华夏中证 500ETF 联接 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.67%	1.05%	6.74%	1.05%	0.93%	0.00%

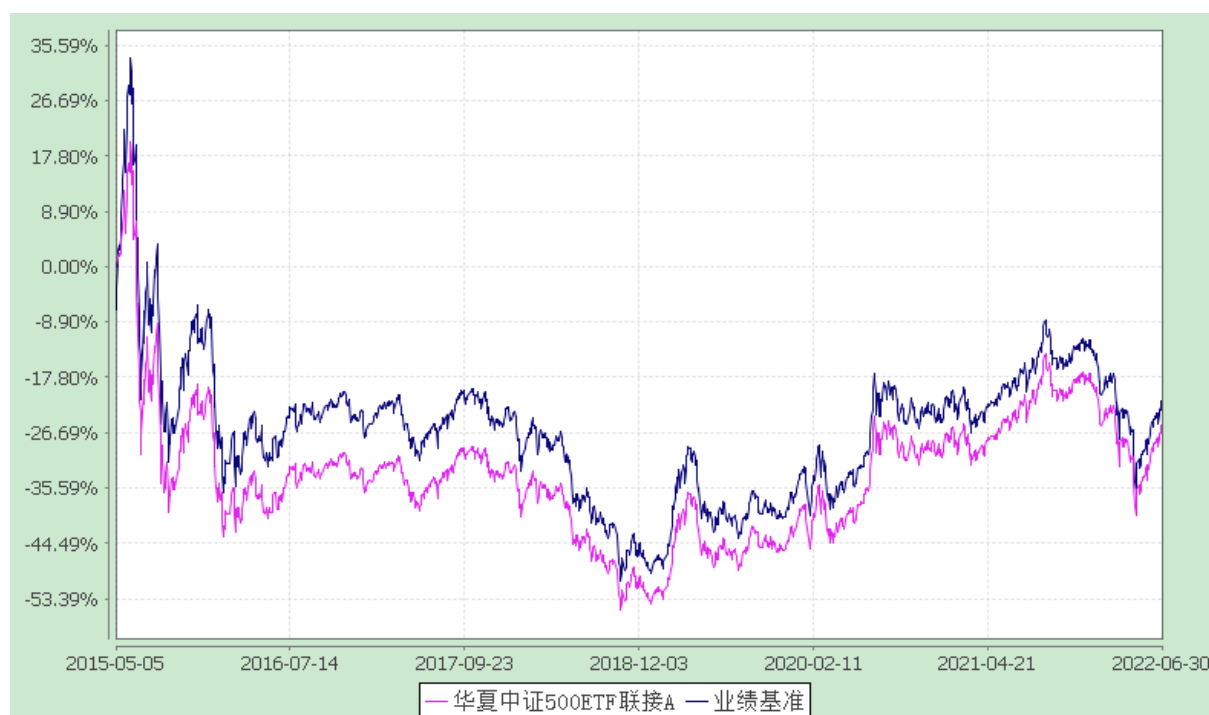
过去三个月	3.19%	1.65%	1.99%	1.66%	1.20%	-0.01%
过去六个月	-10.66%	1.54%	-11.65%	1.55%	0.99%	-0.01%
过去一年	-3.72%	1.25%	-4.83%	1.26%	1.11%	-0.01%
过去三年	34.21%	1.28%	29.13%	1.28%	5.08%	0.00%
自新增分级以来至今	40.40%	1.36%	34.87%	1.37%	5.53%	-0.01%

注：本基金自 2018 年 9 月 19 日起增加 C 类基金份额类别。

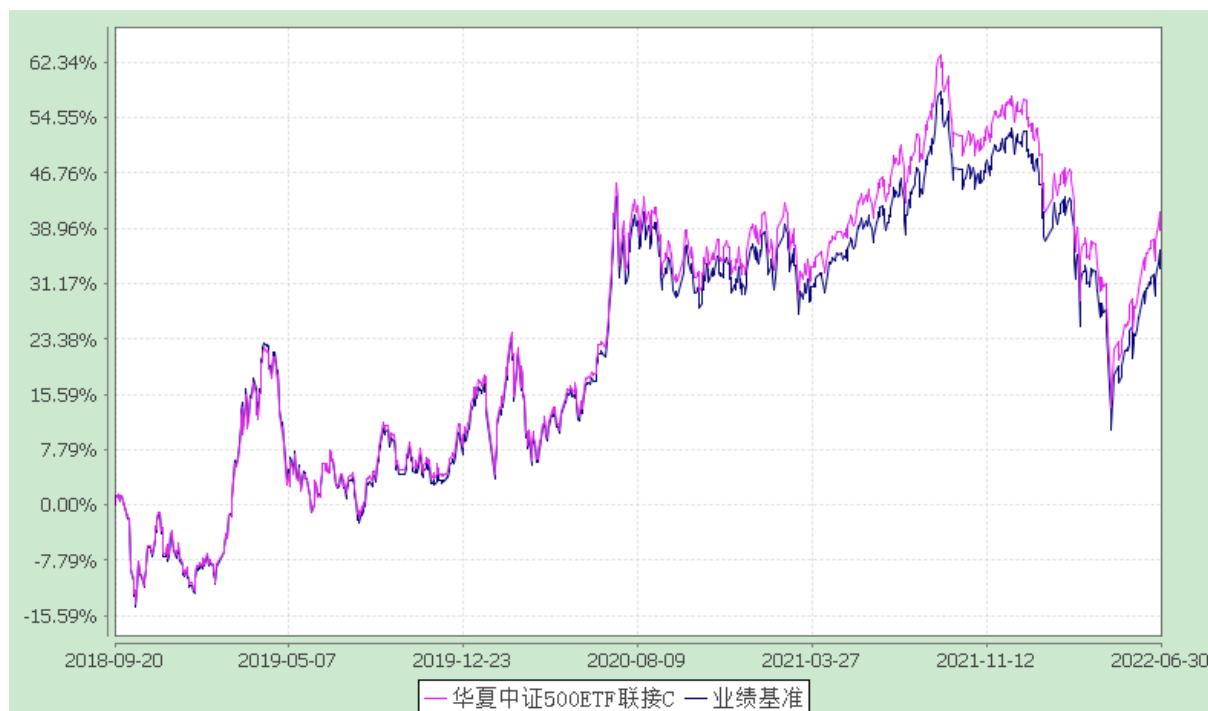
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2015 年 5 月 5 日至 2022 年 6 月 30 日)

#### 华夏中证 500ETF 联接 A



#### 华夏中证 500ETF 联接 C



注：本基金自 2018 年 9 月 19 日起增加 C 类基金份额类别。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人，首批商品期货 ETF 基金管理人，以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、海外市场指数、信用债指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河



证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》，截至 2022 年 6 月 30 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先（基金排名不作为产品未来表现的保证），其中：

主动权益产品：在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中华夏兴和混合排序第 1/188、华夏兴华混合(A 类)排序第 16/188；在养老目标日期 FOF(2040)(A 类)中华夏养老 2040 三年持有混合（FOF）排序第 2/14；在定开偏股型基金(A 类)中华夏磐利一年定开混合(A 类)排序第 2/77、华夏磐锐一年定开混合(A 类)排序第 10/77、华夏磐益一年定开混合排序第 11/77、华夏成长精选 6 个月定开混合(A 类)排序第 24/77；在医药医疗健康行业偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏逸享健康混合(A 类)排序第 9/52；在消费行业偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏网购精选混合(A 类)排序第 10/53；在偏股型基金(股票上限 80%)(A 类)中华夏经典混合排序第 22/134；在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏行业景气混合排序第 29/905、华夏产业升级混合(A 类)排序第 55/905、华夏盛世混合排序第 67/905；在标准股票型基金(A 类)中华夏智胜价值成长股票(A 类)排序第 59/286；在灵活配置型基金(基准股票比例 60%-100%)(A 类)中华夏圆和混合(A 类)排序第 74/436。

固收与固收+产品：在 QDII 债券型基金(A 类)中华夏大中华信用债券(QDII)(A 类)排序第 1/25；在信用债指数债券型基金(A 类)中华夏亚债中国指数(A 类)排序第 3/13；在利率债指数债券型基金(A 类)中华夏中债 3-5 年政金债指数(A 类)排序第 7/98；在中短期纯债债券型基金(A 类)中华夏中短债债券(A 类)排序第 21/84；在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎航债券(A 类)排序第 28/642；在偏债型基金(A 类)中华夏磐泰混合（LOF）(A 类)排序第 32/350、华夏睿磐泰盛混合排序第 36/350、华夏永康添福混合(A 类)排序第 46/350、华夏睿磐泰利混合(A 类)排序第 63/350。

指数与量化产品：在 QDII 跨境股票 ETF 基金中华夏纳斯达克 100ETF（QDII）排序第 4/19；在规模指数股票 ETF 基金中华夏中证 1000ETF 排序第 3/116、华夏中证 500ETF 排序第 18/116；在主题指数股票 ETF 联接基金(A 类)中华夏中证四川国改 ETF 联接(A 类)排序第 3/60、华夏中证央企 ETF 联接(A 类)排序第 15/60；在行业指数股票 ETF 联接基金(A 类)中华夏中证全指房地产 ETF 联接(A 类)排序第 4/24、华夏中证银行 ETF 联接(A 类)排序第 6/24；在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证全指房地产 ETF 排序第 7/41、华夏中证银行 ETF 排序第 10/41；在规模指数股票 ETF 联接基金(A 类)中华夏中证 500ETF 联接(A 类)排序第 15/80；在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证新能源 ETF 排序第 14/169、华夏中证四川国改 ETF 排序第 17/169、华夏中证新能源汽车 ETF 排序第 24/169。

在证券时报主办的第十七届中国基金业明星基金奖评选活动上，在最具含金量、最能体现基金公司综合实力的“年度十大明星基金公司奖”评选中，华夏基金凭借在多项业务中的优异中长期表现，成功获奖。此外，凭借 QDII 基金的良好业绩表现，以及在境内外市场的持续布局，华夏基金还获得“三年海外投资明星基金公司奖”。

在客户服务方面，2022 年上半年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金直销上线北京银行、广发银行快捷等支付方式，拓展支付渠道的同时交易额度也得到进一步提升，满足客户支付需求；（2）华夏基金管家客户端优化资料上传、定投收益展示等功能，增加客户操作便利性；（3）与兰州银行、九江银行、晋商银行、九州证券等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“压岁钱手账”、“基金视力表”、“与干饭人灵魂相认”、“童言童语话理财”、“FOF 产品不是小透明”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
荣膺	本基金的基金经理、投委会成员	2016-10-20	-	12 年	硕士。2010 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任研究发展部高级产品经理，数量投资部研究员、投资经理、基金经理助理、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期间）、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期间）、上证主要消费交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2015 年 11 月 6 日至 2020 年 3 月 18 日期间）、华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金经理（2018 年 3 月 6 日至 2020 年 3 月 18 日期间）、华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2018 年 9 月 17 日至 2021 年 10 月 21 日期间）、华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2018 年 9 月 17 日至 2021 年 10 月 21 日期间）、华夏中证央企结构调整交易型

					开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2018 年 11 月 14 日至 2021 年 10 月 21 日期间）、华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2019 年 6 月 26 日至 2021 年 10 月 21 日期间）等。
--	--	--	--	--	---

注：①上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 54 次，其中 3 次为投资策略需要所致，为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理已根据管理要求提供决策依据；其余均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证 500 指数，基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%。中证 500 指数成份股是在扣除沪深 300 指数样本股及最近一年日均总

市值排名前 300 名的股票后，选取成交金额及日均总市值排名在前 500 名的股票，中证 500 指数综合反映沪深证券市场内小市值公司的整体状况。本基金通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标 ETF（中证 500 交易型开放式指数证券投资基金），从而实现基金投资目标，基金也可以通过买入中证 500 指数成份股来跟踪标的指数。

上半年，国内疫情一度遭遇反复，常态化核酸检测似乎是目前平衡疫情防控和经济发展的有效手段，国内就业压力较大，房地产行业下行。货币和信用持续保持宽松，积极的财政政策和各种产业政策托底经济，房地产继续因城施策、保持定力，鼓励平台经济健康发展。

海外通胀压力加大，欧美央行纷纷加息，欧元区负利率债券大面积消失，全球流动性成本上升，发达经济体面临以牺牲经济增长为代价对抗通胀的艰难处境。

市场方面，上半年 A 股经历过山车，背后的经济周期是内在下行动力，积极的财政和货币政策是反弹上行动力，市场筹码结构的变化加大了波动幅度。市场贝塔的大幅波动，使得宽基 ETF 在抄底时的工具化优势得以显现。结构方面，下跌阶段低估值行业表现出相对收益，反弹阶段新能源赛道表现出弹性。市场主线依旧是围绕能源行业，代表旧能源的煤炭、石油表现优异，代表新能源的新能源车、光伏、风电、储能备受追捧。

基金投资运作方面，报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，华夏中证 500ETF 联接 A 份额净值为 0.7409 元，本报告期份额净值增长率为-10.47%，同期业绩比较基准增长率-11.65%，本报告期跟踪偏离度为+1.18%；华夏中证 500ETF 联接 C 份额净值为 0.7301 元，本报告期份额净值增长率为-10.66%，同期业绩比较基准增长率-11.65%，本报告期跟踪偏离度为+0.99%。与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济处于衰退象限向复苏象限转换的阶段，财政和货币政策依旧对宏观经济有利，通胀不会成为掣肘货币政策的因素；欧美处于加息抑制通胀的阶段，经济周期逐步向衰退转化，因此我国在相对有利的周期位置上，全球视角下的人民币资产具备相对吸引力。如果发生以下风险，将会提供非常好的长期配置机会，譬如美联储缩表对全球流动性显现出负面影响，海外经济衰退预期加剧引发国内出口担忧。内因是事物变化的根据，外因是事物变化的条件。未来一旦国内经济迈入复苏象限，很可能意味着市场新一轮上升周期的开始。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为

信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人作为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §6 中期报告财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	170,532,847.65	145,615,042.39
结算备付金		17,695,829.36	50,052,273.39
存出保证金		8,645,638.76	7,336,679.18
交易性金融资产	6.4.7.2	2,346,369,882.13	2,598,184,615.59
其中：股票投资		8,523,061.27	169,034.00
基金投资		2,337,846,320.77	2,598,015,581.59
债券投资		500.09	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	3,842,945.28
应收股利		-	-
应收申购款		1,876,568.83	3,159,075.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	41,452.11
资产总计		2,545,120,766.73	2,808,232,083.92
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		6,255,441.68	11,976,814.69
应付管理人报酬		79,304.78	82,731.96
应付托管费		15,860.93	16,546.38
应付销售服务费		36,829.51	66,960.45
应付投资顾问费		-	-

应交税费		169,675.41	922,563.56
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	96,602.34	177,302.86
负债合计		6,653,714.65	13,242,919.90
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	3,428,645,167.04	3,381,001,737.98
未分配利润	6.4.7.8	-890,178,114.96	-586,012,573.96
净资产合计		2,538,467,052.08	2,794,989,164.02
负债和净资产总计		2,545,120,766.73	2,808,232,083.92

注：①报告截止日 2022 年 6 月 30 日，华夏中证 500ETF 联接 A 基金份额净值 0.7409 元，华夏中证 500ETF 联接 C 基金份额净值 0.7301 元；华夏中证 500ETF 联接基金份额总额 3,428,645,167.04 份（其中 A 类 3,272,641,237.36 份，C 类 156,003,929.68 份）。

②以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-280,198,538.85	185,931,968.72
1.利息收入		445,658.14	650,671.79
其中：存款利息收入	6.4.7.9	445,658.14	577,538.47
债券利息收入		-	73,133.32
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		21,835,087.93	106,313,235.69
其中：股票投资收益	6.4.7.10	13,701.24	-63,623.83
基金投资收益	6.4.7.11	24,132,552.57	103,801,721.48
债券投资收益	6.4.7.12	0.09	-11,950.00

资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-2,395,557.59	2,587,106.79
股利收益	6.4.7.15	84,391.62	-18.75
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-302,659,015.80	78,360,684.70
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	179,730.88	607,376.54
<b>减：二、营业总支出</b>		985,237.20	1,269,155.60
1.管理人报酬		441,747.46	436,801.12
2.托管费		88,349.47	87,360.27
3.销售服务费		292,335.60	245,113.61
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		78,342.11	275,360.98
8.其他费用	6.4.7.19	84,462.56	224,519.62
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-281,183,776.05	184,662,813.12
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-281,183,776.05	184,662,813.12
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-281,183,776.05	184,662,813.12

注：以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	3,381,001,737.98	-	-586,012,573.96	2,794,989,164.02
二、本期期初净资产	3,381,001,737.98	-	-586,012,573.96	2,794,989,164.02



产（基金净值）				
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	47,643,429.06	-	-304,165,541.00	-256,522,111.94
（一）、综合收益总额	-	-	-281,183,776.05	-281,183,776.05
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	47,643,429.06	-	-22,981,764.95	24,661,664.11
其中：1.基金申购款	610,571,675.02	-	-174,617,784.45	435,953,890.57
2.基金赎回款	-562,928,245.96	-	151,636,019.50	-411,292,226.46
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	3,428,645,167.04	-	-890,178,114.96	2,538,467,052.08
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	3,535,180,171.40	-	-1,018,217,103.04	2,516,963,068.36
二、本期期初净资产（基金净值）	3,535,180,171.40	-	-1,018,217,103.04	2,516,963,068.36
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-256,038,477.08	-	250,654,159.85	-5,384,317.23
（一）、综合收益总额	-	-	184,662,813.12	184,662,813.12
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-256,038,477.08	-	65,991,346.73	-190,047,130.35
其中：1.基金申购款	995,378,642.30	-	-273,207,021.78	722,171,620.52
2.基金赎回款	-1,251,417,119.38	-	339,198,368.51	-912,218,750.87

（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	3,279,141,694.32	-	-767,562,943.19	2,511,578,751.13

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：杨明辉，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

#### 6.4 报表附注

##### 6.4.1 基金基本情况

华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]113 号《关于准予华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2015 年 4 月 8 日至 2015 年 4 月 28 日期间共募集 1,638,340,615.47 元（不含认购资金利息），业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）德师报（验）字（15）第 0536 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2015 年 5 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,639,232,278.45 份基金份额，其中认购资金利息折合 891,662.98 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。本基金自 2018 年 9 月 19 日起新增 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股、债券（含中小企业私募债券）、股指期货、权证、国债期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金投资范围中的股票包含存托凭证。

##### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）

颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则的累积影响数调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，将金融工具分类为以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

新金融工具准则要求对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于 2021 年 12 月 31 日，银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、交易性金融资产、卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产、卖出回购金融资产款等科目项下列示，同时以

摊余成本法计量的金融资产按照预期信用损失为基准，计提损失准备 0.00 元，对本基金期初未分配利润无影响。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 145,615,042.39 元、50,052,273.39 元、7,336,679.18 元、41,452.11 元、3,842,945.28 元和 3,159,075.98 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 145,630,393.32 元、50,078,319.90 元、7,336,733.85 元、0.00 元、3,842,945.28 元和 3,159,075.98 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 2,598,184,615.59 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 2,598,184,615.59 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-其他应付款，金额分别为 11,976,814.69 元、82,731.96 元、16,546.38 元、66,960.45 元和 177,302.86 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-其他应付款，金额分别为 11,976,814.69 元、82,731.96 元、16,546.38 元、66,960.45 元和 177,302.86 元。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税

政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

(2) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

(3) 基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。

(4) 存款利息收入不征收增值税。

(5) 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

(6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(7) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(8) 对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10% 的税率代扣所得税。

(9) 基金在境内卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(10) 基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

(11) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和

地方教育费附加。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	170,532,847.65
等于：本金	170,516,793.92
加：应计利息	16,053.73
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	170,532,847.65

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	7,744,516.75	-	8,523,061.27	778,544.52
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	0.09	500.09	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	500.00	500.09	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	1,962,047,084.20	-	2,337,846,320.77	375,799,236.57
其他	-	-	-	-
合计	1,969,792,100.95	0.09	2,346,369,882.13	376,577,781.09

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

###### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	58,766,040.00	-	-	-
其中：股指期货	58,766,040.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	58,766,040.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2209	中证 500 期 货 IC2209 合约	48.00	61,094,400.00	2,328,360.00
合计	-	-	-	2,328,360.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	2,328,360.00
净额	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8,465.05
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	3,834.73
其中：交易所市场	3,834.73
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
合计	96,602.34

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 华夏中证 500ETF 联接 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	3,096,756,612.78	3,096,756,612.78
本期申购	456,634,180.89	456,634,180.89
本期赎回（以“-”号填列）	-280,749,556.31	-280,749,556.31
本期末	3,272,641,237.36	3,272,641,237.36

##### 华夏中证 500ETF 联接 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	284,245,125.20	284,245,125.20
本期申购	153,937,494.13	153,937,494.13
本期赎回（以“-”号填列）	-282,178,689.65	-282,178,689.65
本期末	156,003,929.68	156,003,929.68

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 华夏中证 500ETF 联接 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-75,133,160.45	-458,914,693.54	-534,047,853.99
本期利润	20,353,978.18	-279,761,722.82	-259,407,744.64
本期基金份额交易产生的变动数	-3,421,421.58	-51,201,686.59	-54,623,108.17
其中：基金申购款	-9,242,964.59	-120,946,348.36	-130,189,312.95
基金赎回款	5,821,543.01	69,744,661.77	75,566,204.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-58,200,603.85	-789,878,102.95	-848,078,706.80

##### 华夏中证 500ETF 联接 C

单位：人民币元



项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-122,314,419.26	70,349,699.29	-51,964,719.97
本期利润	1,121,261.57	-22,897,292.98	-21,776,031.41
本期基金份额交易产生的变动数	54,839,611.99	-23,198,268.77	31,641,343.22
其中：基金申购款	-65,778,590.71	21,350,119.21	-44,428,471.50
基金赎回款	120,618,202.70	-44,548,387.98	76,069,814.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-66,353,545.70	24,254,137.54	-42,099,408.16

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	271,872.09
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	172,863.87
其他	922.18
合计	445,658.14

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-5,252.11
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	18,953.35
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	13,701.24

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	-
减：卖出股票成本总额	-
减：交易费用	5,252.11
买卖股票差价收入	-5,252.11

##### 6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

无。

#### 6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	5,114,400.00
减：现金支付申购款总额	2,481,853.06
减：申购股票成本总额	2,613,593.59
减：交易费用	-
申购差价收入	18,953.35

#### 6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	140,289,457.00
减：卖出/赎回基金成本总额	115,420,666.87
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	724,333.69
减：交易费用	11,903.87
基金投资收益	24,132,552.57

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	0.09
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	0.09

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股指期货投资收益	-2,395,557.59

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	84,391.62
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	84,391.62

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	-304,429,735.80
——股票投资	745,124.76
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-305,174,860.56
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	1,770,720.00
——权证投资	-
——期货投资	1,770,720.00
4.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-302,659,015.80

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	179,730.88
基金申购费收入	-
合计	179,730.88

#### 6.4.7.18 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	160.00
合计	84,462.56

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（“目标 ETF”）	本基金是该基金的联接基金
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
上海华夏财富投资管理有限公司（“华夏财富”）	基金管理人的子公司
中信证券华南股份有限公司（“中信证券（华南）”）	基金管理人股东控股的公司
中信期货有限公司（“中信期货”）	基金管理人股东控股的公司
中信证券（山东）有限责任公司（“中信证券（山东）”）	基金管理人股东控股的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	7,751,004.30	75.82%	87,982,519.69	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	3,343.40	75.82%	2,768.74	72.20%
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	37,947.96	100.00%	24.61	0.01%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	441,747.46	436,801.12
其中：支付销售机构的客户维护费	1,699,018.83	1,539,135.62

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(剩余部分若为负数则取 0)的 0.50%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=(前一日基金资产净值-前一日基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值) ×0.50%/当年天数。若前一日基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分为负数，则按 0 计算。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	88,349.47	87,360.27

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(剩余部分若为负数则取 0)的 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=（前一日基金资产净值-前一日基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值） ×0.10%/当年天数。若前一日基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分为负数，则按 0 计算。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
华夏中证 500ETF 联接 A	华夏中证 500ETF 联接 C	合计	
华夏基金管理有限公司	-	181,662.46	181,662.46

华夏财富	-	14,426.37	14,426.37
中信证券	-	659.72	659.72
中信证券 (华南)	-	113.21	113.21
中信期货	-	88.32	88.32
中信证券 (山东)	-	28.14	28.14
合计	-	196,978.22	196,978.22
获得销售服 务费的各关 联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏中证 500ETF 联 接 A	华夏中证 500ETF 联接 C	合计
华夏基金管 理有限公司	-	202,494.91	202,494.91
华夏财富	-	12,084.81	12,084.81
中信证券	-	28.97	28.97
中信期货	-	14.24	14.24
中信证券 (华南)	-	10.64	10.64
合计	-	214,633.57	214,633.57

注：①支付基金销售机构的基金销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

②基金销售服务费计算公式为：C 类日基金销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行活期存款	170,532,847.65	271,872.09	135,231,800.67	229,478.17

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期通过中信期货买卖股指期货成交额为 412,214,840.00 元（上年度可比期间：461,710,680.00 元），支付给中信期货的佣金为 10,099.27 元（上年度可比期间为：11,311.92 元）。

截至 2022 年 6 月 30 日止，本基金持有 684,040,823 份目标 ETF 基金份额（2021 年 12 月 31 日：675,440,823 份），占其总份额的比例为 56.07%（2021 年 12 月 31 日：43.21%）。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127064	杭氧转债	2022-05-19	6 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.02	5	500.00	500.09	期末估值单价为



											含息价格
--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	------

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002670	国盛金控	2022-06-01	重大事项	9.60	2022-07-14	9.99	1,100	10,774.00	10,560.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评

级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于流动性较好的目标 ETF 基金，基金管理人持续监测目标 ETF 基金的市场交易量、申赎情况及标的指数成份股流动性等影响资产流动性的因素，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金主要通过投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股来跟踪标的指数。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

##### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金

持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股。本基金的其他价格风险与目标 ETF 基金相似。本基金管理人通常用敏感性指标来衡量市场价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	8,523,061.27	0.34	169,034.00	0.01
交易性金融资产—基金投资	2,337,846,320.77	92.10	2,598,015,581.59	92.95
交易性金融资产—债券投资	500.09	0.00	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,346,369,882.13	92.43	2,598,184,615.59	92.96

注：①本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 500 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	-5%	-115,297,875.93	-117,084,592.33
	+5%	115,297,875.93	117,084,592.33

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	2,346,359,322.13
第二层次	10,560.00
第三层次	-
合计	2,346,369,882.13

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2022 年 6 月 30 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，其账面价值与公允价值差异很小。

##### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	8,523,061.27	0.33
	其中：股票	8,523,061.27	0.33
2	基金投资	2,337,846,320.77	91.86
3	固定收益投资	500.09	0.00

	其中：债券	500.09	0.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	188,228,677.01	7.40
8	其他各项资产	10,522,207.59	0.41
9	合计	2,545,120,766.73	100.00

## 7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	华夏中证 500ETF	股票型	交易型开放式	华夏基金管理有限公司	2,337,846,320.77	92.10

## 7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	78,644.00	0.00
B	采矿业	504,126.00	0.02
C	制造业	4,913,993.47	0.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	347,400.00	0.01
E	建筑业	190,621.00	0.01
F	批发和零售业	348,112.20	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	313,439.00	0.01
H	住宿和餐饮业	75,120.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	565,806.10	0.02
J	金融业	620,988.50	0.02
K	房地产业	227,609.00	0.01
L	租赁和商务服务业	79,651.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	38,585.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	60,105.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	12,440.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	89,772.00	0.00
S	综合	56,649.00	0.00
	合计	8,523,061.27	0.34

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601608	中信重工	36,300	137,577.00	0.01
2	600522	中天科技	4,700	108,570.00	0.00
3	601615	明阳智能	2,600	87,880.00	0.00
4	600256	广汇能源	8,200	86,428.00	0.00
5	600188	兖矿能源	1,600	63,168.00	0.00
6	600157	永泰能源	39,600	62,964.00	0.00
7	688005	容百科技	479	62,001.76	0.00
8	600141	兴发集团	1,400	61,586.00	0.00
9	600392	盛和资源	2,500	56,500.00	0.00
10	600884	杉杉股份	1,900	56,468.00	0.00
11	601689	拓普集团	800	54,744.00	0.00
12	603613	国联股份	600	53,160.00	0.00
13	600885	宏发股份	1,260	52,731.00	0.00
14	600765	中航重机	1,600	51,488.00	0.00
15	601117	中国化学	5,400	50,814.00	0.00
16	600754	锦江酒店	800	50,320.00	0.00
17	600399	抚顺特钢	2,800	50,120.00	0.00
18	601555	东吴证券	7,200	49,896.00	0.00
19	600732	爱旭股份	1,500	49,530.00	0.00
20	600487	亨通光电	3,400	49,436.00	0.00
21	300751	迈为股份	100	49,090.00	0.00
22	600233	圆通速递	2,400	48,936.00	0.00
23	605358	立昂微	700	47,166.00	0.00
24	603077	和邦生物	11,000	46,860.00	0.00
25	603456	九洲药业	900	46,530.00	0.00
26	600418	江淮汽车	2,700	46,332.00	0.00
27	603605	珀莱雅	280	46,250.40	0.00
28	688099	晶晨股份	439	44,339.00	0.00
29	600298	安琪酵母	900	43,875.00	0.00
30	600862	中航高科	1,500	42,150.00	0.00
31	600563	法拉电子	200	41,032.00	0.00
32	002340	格林美	4,500	40,950.00	0.00
33	000733	振华科技	300	40,791.00	0.00
34	601077	渝农商行	11,000	40,700.00	0.00
35	600153	建发股份	3,100	40,517.00	0.00
36	601168	西部矿业	3,400	40,222.00	0.00
37	600486	扬农化工	300	39,984.00	0.00
38	603444	吉比特	100	38,800.00	0.00

39	603290	斯达半导	100	38,590.00	0.00
40	600988	赤峰黄金	2,400	38,280.00	0.00
41	601128	常熟银行	4,900	37,436.00	0.00
42	601636	旗滨集团	2,900	36,975.00	0.00
43	600521	华海药业	1,600	36,320.00	0.00
44	002180	纳思达	700	35,434.00	0.00
45	600733	北汽蓝谷	3,800	35,226.00	0.00
46	603589	口子窖	600	35,166.00	0.00
47	600546	山煤国际	1,800	35,028.00	0.00
48	603127	昭衍新药	300	34,140.00	0.00
49	601872	招商轮船	5,800	33,408.00	0.00
50	600875	东方电气	2,000	32,900.00	0.00
51	600705	中航产融	9,500	32,870.00	0.00
52	600497	驰宏锌锗	6,300	32,697.00	0.00
53	600177	雅戈尔	4,900	32,487.00	0.00
54	600348	华阳股份	2,100	32,466.00	0.00
55	600549	厦门钨业	1,500	32,430.00	0.00
56	000009	中国宝安	2,400	32,376.00	0.00
57	300763	锦浪科技	150	31,950.00	0.00
58	600160	巨化股份	2,400	31,560.00	0.00
59	600516	方大炭素	4,100	31,160.00	0.00
60	601699	潞安环能	2,100	30,702.00	0.00
61	600482	中国动力	1,900	29,849.00	0.00
62	002384	东山精密	1,300	29,809.00	0.00
63	000723	美锦能源	2,400	29,280.00	0.00
64	600704	物产中大	5,600	28,728.00	0.00
65	300037	新宙邦	540	28,382.40	0.00
66	600803	新奥股份	1,500	27,885.00	0.00
67	600739	辽宁成大	1,900	27,702.00	0.00
68	600039	四川路桥	2,600	27,378.00	0.00
69	600415	小商品城	4,900	27,293.00	0.00
70	603893	瑞芯微	300	27,282.00	0.00
71	600372	中航电子	1,400	27,146.00	0.00
72	603267	鸿远电子	200	26,866.00	0.00
73	601997	贵阳银行	4,600	26,726.00	0.00
74	600699	均胜电子	1,700	26,707.00	0.00
75	600536	中国软件	650	26,383.50	0.00
76	600985	淮北矿业	1,800	26,208.00	0.00
77	603198	迎驾贡酒	400	26,056.00	0.00
78	600859	王府井	1,000	25,980.00	0.00
79	601016	节能风电	5,400	25,920.00	0.00
80	600867	通化东宝	2,500	25,850.00	0.00
81	600026	中远海能	2,500	25,825.00	0.00

82	601198	东兴证券	2,900	25,810.00	0.00
83	002268	卫士通	600	25,746.00	0.00
84	600637	东方明珠	3,600	25,740.00	0.00
85	600315	上海家化	600	25,650.00	0.00
86	600236	桂冠电力	4,200	25,578.00	0.00
87	000983	山西焦煤	1,900	25,441.00	0.00
88	600879	航天电子	3,900	25,311.00	0.00
89	300285	国瓷材料	700	25,144.00	0.00
90	600171	上海贝岭	1,000	25,030.00	0.00
91	600642	申能股份	4,400	24,992.00	0.00
92	601975	招商南油	6,200	24,986.00	0.00
93	600258	首旅酒店	1,000	24,800.00	0.00
94	600673	东阳光	2,700	24,273.00	0.00
95	002385	大北农	3,100	24,211.00	0.00
96	600316	洪都航空	800	24,192.00	0.00
97	600170	上海建工	7,900	23,937.00	0.00
98	600369	西南证券	5,900	23,423.00	0.00
99	600801	华新水泥	1,200	23,412.00	0.00
100	300363	博腾股份	300	23,397.00	0.00
101	603568	伟明环保	700	23,359.00	0.00
102	000519	中兵红箭	800	23,320.00	0.00
103	600166	福田汽车	8,200	23,206.00	0.00
104	600062	华润双鹤	900	23,094.00	0.00
105	600580	卧龙电驱	1,600	23,072.00	0.00
106	601717	郑煤机	1,600	23,056.00	0.00
107	603218	日月股份	900	22,860.00	0.00
108	600027	华电国际	5,800	22,794.00	0.00
109	600909	华安证券	5,000	22,750.00	0.00
110	601005	重庆钢铁	11,900	22,729.00	0.00
111	600325	华发股份	3,000	22,710.00	0.00
112	600008	首创环保	7,800	22,620.00	0.00
113	600038	中直股份	500	22,600.00	0.00
114	000630	铜陵有色	6,900	22,494.00	0.00
115	688065	凯赛生物	200	22,360.00	0.00
115	600529	山东药玻	800	22,360.00	0.00
117	002013	中航机电	1,800	22,230.00	0.00
118	600118	中国卫星	1,100	22,088.00	0.00
119	600271	航天信息	2,000	21,880.00	0.00
120	688521	芯原股份	441	21,785.40	0.00
121	002028	思源电气	600	21,396.00	0.00
122	601866	中远海发	7,100	21,300.00	0.00
123	002056	横店东磁	800	21,296.00	0.00
124	600208	新潮中宝	7,700	21,252.00	0.00



125	300223	北京君正	200	21,250.00	0.00
126	600863	内蒙华电	5,800	21,170.00	0.00
127	600380	健康元	1,700	20,995.00	0.00
128	000988	华工科技	900	20,853.00	0.00
129	600820	隧道股份	3,400	20,808.00	0.00
130	600066	宇通客车	2,400	20,760.00	0.00
131	600056	中国医药	1,400	20,748.00	0.00
132	601992	金隅集团	7,400	20,498.00	0.00
133	603156	养元饮品	900	20,448.00	0.00
134	600259	广晟有色	400	20,260.00	0.00
135	600998	九州通	1,700	20,247.00	0.00
136	002353	杰瑞股份	500	20,150.00	0.00
137	002797	第一创业	3,100	19,871.00	0.00
138	000932	华菱钢铁	3,900	19,851.00	0.00
139	603885	吉祥航空	1,100	19,789.00	0.00
140	603707	健友股份	700	19,740.00	0.00
141	603858	步长制药	1,000	19,710.00	0.00
142	002185	华天科技	2,100	19,698.00	0.00
143	600390	五矿资本	4,000	19,560.00	0.00
144	600755	厦门国贸	2,600	19,500.00	0.00
145	002603	以岭药业	800	19,440.00	0.00
146	600970	中材国际	2,000	19,380.00	0.00
147	600528	中铁工业	2,400	19,320.00	0.00
148	600598	北大荒	1,300	19,188.00	0.00
148	600667	太极实业	2,600	19,188.00	0.00
150	600839	四川长虹	6,600	19,008.00	0.00
151	603712	七一二	600	18,900.00	0.00
152	688002	睿创微纳	475	18,867.00	0.00
153	600297	广汇汽车	7,200	18,792.00	0.00
154	600511	国药股份	700	18,746.00	0.00
155	600155	华创阳安	2,200	18,656.00	0.00
156	600827	百联股份	1,400	18,494.00	0.00
157	002078	太阳纸业	1,500	18,465.00	0.00
158	600201	生物股份	2,000	18,320.00	0.00
159	000728	国元证券	2,900	18,038.00	0.00
160	600409	三友化工	2,200	18,018.00	0.00
161	000999	华润三九	400	18,000.00	0.00
162	300724	捷佳伟创	200	17,870.00	0.00
163	300699	光威复材	300	17,661.00	0.00
164	600060	海信视像	1,400	17,500.00	0.00
165	600895	张江高科	1,400	17,430.00	0.00
166	600498	烽火通信	1,200	17,376.00	0.00
167	600282	南钢股份	5,500	17,325.00	0.00

168	300146	汤臣倍健	800	17,320.00	0.00
169	601179	中国西电	3,700	17,316.00	0.00
170	600718	东软集团	1,500	17,265.00	0.00
171	002507	涪陵榨菜	500	17,260.00	0.00
172	601880	辽港股份	10,100	17,170.00	0.00
173	600782	新钢股份	3,400	17,136.00	0.00
174	002557	洽洽食品	300	17,079.00	0.00
175	300088	长信科技	2,300	17,066.00	0.00
176	000970	中科三环	900	16,902.00	0.00
177	600022	山东钢铁	9,700	16,878.00	0.00
178	000738	航发控制	600	16,860.00	0.00
179	600535	天士力	1,600	16,816.00	0.00
180	000998	隆平高科	1,000	16,660.00	0.00
181	601577	长沙银行	2,100	16,653.00	0.00
181	002409	雅克科技	300	16,653.00	0.00
183	600500	中化国际	2,500	16,625.00	0.00
184	600663	陆家嘴	1,600	16,576.00	0.00
185	603866	桃李面包	1,000	16,550.00	0.00
186	002572	索菲亚	600	16,500.00	0.00
186	002080	中材科技	600	16,500.00	0.00
186	600064	南京高科	1,500	16,500.00	0.00
189	600216	浙江医药	1,200	16,380.00	0.00
190	002138	顺络电子	600	16,350.00	0.00
190	002673	西部证券	2,500	16,350.00	0.00
192	600808	马钢股份	4,300	16,297.00	0.00
193	600566	济川药业	600	16,296.00	0.00
194	603225	新凤鸣	1,400	16,156.00	0.00
195	600728	佳都科技	2,500	16,150.00	0.00
196	600517	国网英大	3,100	16,089.00	0.00
197	600567	山鹰国际	5,800	16,066.00	0.00
198	600037	歌华有线	1,700	15,963.00	0.00
199	601456	国联证券	1,300	15,951.00	0.00
200	688208	道通科技	481	15,834.52	0.00
201	000807	云铝股份	1,600	15,808.00	0.00
202	300357	我武生物	300	15,609.00	0.00
203	000975	银泰黄金	1,600	15,584.00	0.00
204	300308	中际旭创	500	15,525.00	0.00
205	002030	达安基因	900	15,471.00	0.00
206	002465	海格通信	1,700	15,453.00	0.00
207	002223	鱼跃医疗	600	15,396.00	0.00
208	000039	中集集团	1,100	15,235.00	0.00
209	600908	无锡银行	2,700	15,201.00	0.00
210	000629	攀钢钒钛	4,000	15,200.00	0.00

211	300136	信维通信	900	15,165.00	0.00
212	600597	光明乳业	1,200	15,156.00	0.00
213	000960	锡业股份	900	15,093.00	0.00
214	601106	中国一重	4,900	15,043.00	0.00
215	601958	金铂股份	1,700	15,028.00	0.00
216	300058	蓝色光标	2,300	15,019.00	0.00
217	600811	东方集团	5,300	14,999.00	0.00
218	002422	科伦药业	800	14,960.00	0.00
219	600507	方大特钢	2,100	14,679.00	0.00
220	600572	康恩贝	3,300	14,619.00	0.00
221	601718	际华集团	4,700	14,570.00	0.00
222	002372	伟星新材	600	14,424.00	0.00
223	002508	老板电器	400	14,412.00	0.00
224	300418	昆仑万维	900	14,400.00	0.00
225	600021	上海电力	1,400	14,350.00	0.00
226	601118	海南橡胶	3,000	14,340.00	0.00
227	000547	航天发展	1,200	14,328.00	0.00
228	600737	中粮糖业	1,900	14,288.00	0.00
229	002506	协鑫集成	3,800	14,136.00	0.00
230	300253	卫宁健康	1,600	14,048.00	0.00
231	601778	晶科科技	2,600	14,040.00	0.00
232	688006	杭可科技	200	14,012.00	0.00
233	603927	中科软	600	13,992.00	0.00
234	002439	启明星辰	700	13,951.00	0.00
235	300296	利亚德	1,900	13,870.00	0.00
236	600582	天地科技	2,900	13,862.00	0.00
237	002156	通富微电	900	13,860.00	0.00
238	600435	北方导航	1,600	13,792.00	0.00
239	600967	内蒙一机	1,500	13,680.00	0.00
240	601000	唐山港	5,300	13,674.00	0.00
241	002739	万达电影	1,000	13,650.00	0.00
242	600195	中牧股份	1,100	13,486.00	0.00
243	002299	圣农发展	700	13,426.00	0.00
244	000623	吉林敖东	900	13,284.00	0.00
245	603883	老百姓	390	13,213.20	0.00
246	002092	中泰化学	1,700	13,192.00	0.00
247	000636	风华高科	700	13,153.00	0.00
248	300026	红日药业	1,700	13,090.00	0.00
249	601333	广深铁路	6,000	13,080.00	0.00
250	000750	国海证券	3,600	13,068.00	0.00
251	002936	郑州银行	4,800	12,912.00	0.00
252	000887	中鼎股份	700	12,768.00	0.00
253	002203	海亮股份	1,100	12,705.00	0.00

254	600764	中国海防	500	12,620.00	0.00
255	000729	燕京啤酒	1,300	12,558.00	0.00
256	300383	光环新网	1,200	12,504.00	0.00
256	002430	杭氧股份	400	12,504.00	0.00
258	600446	金证股份	1,200	12,456.00	0.00
259	300244	迪安诊断	400	12,440.00	0.00
260	600120	浙江东方	3,100	12,431.00	0.00
261	000739	普洛药业	600	12,384.00	0.00
262	300017	网宿科技	2,300	12,328.00	0.00
263	603638	艾迪精密	600	12,300.00	0.00
264	600329	达仁堂	500	12,290.00	0.00
265	600126	杭钢股份	2,400	12,288.00	0.00
266	601098	中南传媒	1,300	12,272.00	0.00
267	002131	利欧股份	6,300	12,222.00	0.00
268	300482	万孚生物	300	12,213.00	0.00
269	601200	上海环境	1,200	12,192.00	0.00
270	600707	彩虹股份	2,600	12,168.00	0.00
271	002273	水晶光电	1,000	12,110.00	0.00
272	600131	国网信通	900	12,105.00	0.00
273	300024	机器人	1,200	12,096.00	0.00
274	600373	中文传媒	1,200	11,988.00	0.00
275	600167	联美控股	1,600	11,984.00	0.00
276	002195	二三四五	5,300	11,925.00	0.00
277	002926	华西证券	1,500	11,760.00	0.00
278	601611	中国核建	1,400	11,746.00	0.00
279	600959	江苏有线	3,600	11,736.00	0.00
280	603228	景旺电子	500	11,665.00	0.00
281	300618	寒锐钴业	200	11,584.00	0.00
282	000027	深圳能源	1,800	11,538.00	0.00
283	600158	中体产业	1,400	11,522.00	0.00
284	000400	许继电气	600	11,520.00	0.00
285	002500	山西证券	2,000	11,480.00	0.00
286	002250	联化科技	700	11,459.00	0.00
287	000825	太钢不锈	2,100	11,445.00	0.00
288	000878	云南铜业	1,000	11,390.00	0.00
289	603317	天味食品	400	11,388.00	0.00
290	002065	东华软件	1,800	11,376.00	0.00
291	002444	巨星科技	600	11,304.00	0.00
292	600376	首开股份	2,300	11,293.00	0.00
293	002294	信立泰	400	11,240.00	0.00
294	603000	人民网	1,000	11,200.00	0.00
295	002212	天融信	1,100	11,165.00	0.00
296	002683	广东宏大	400	11,132.00	0.00

297	002152	广电运通	1,200	11,124.00	0.00
298	300009	安科生物	1,100	11,121.00	0.00
299	002373	千方科技	1,000	11,120.00	0.00
300	688321	微芯生物	439	11,058.41	0.00
301	002249	大洋电机	1,800	11,052.00	0.00
302	000050	深天马 A	1,100	10,967.00	0.00
303	600398	海澜之家	2,300	10,925.00	0.00
304	600307	酒钢宏兴	5,600	10,864.00	0.00
304	601598	中国外运	2,800	10,864.00	0.00
306	000513	丽珠集团	300	10,863.00	0.00
307	002183	怡亚通	1,500	10,815.00	0.00
308	600906	财达证券	1,200	10,788.00	0.00
309	600901	江苏租赁	2,100	10,773.00	0.00
310	002966	苏州银行	1,760	10,736.00	0.00
311	002191	劲嘉股份	1,000	10,720.00	0.00
312	000060	中金岭南	2,400	10,704.00	0.00
313	601991	大唐发电	4,400	10,692.00	0.00
314	000778	新兴铸管	2,200	10,604.00	0.00
315	000997	新大陆	800	10,568.00	0.00
316	002670	国盛金控	1,100	10,560.00	0.00
317	002408	齐翔腾达	1,300	10,543.00	0.00
318	000401	冀东水泥	1,000	10,520.00	0.00
319	000021	深科技	900	10,476.00	0.00
320	300182	捷成股份	1,900	10,450.00	0.00
321	600717	天津港	2,600	10,426.00	0.00
322	300070	碧水源	2,000	10,420.00	0.00
323	300251	光线传媒	1,100	10,417.00	0.00
324	300001	特锐德	600	10,386.00	0.00
325	300168	万达信息	1,100	10,384.00	0.00
326	002244	滨江集团	1,200	10,380.00	0.00
327	600657	信达地产	1,500	10,335.00	0.00
328	300474	景嘉微	150	10,258.50	0.00
329	002221	东华能源	1,100	10,241.00	0.00
330	002505	鹏都农牧	3,000	10,170.00	0.00
331	600776	东方通信	900	10,125.00	0.00
332	600643	爱建集团	1,700	10,081.00	0.00
333	002128	电投能源	700	10,024.00	0.00
334	601928	凤凰传媒	1,400	10,010.00	0.00
335	600649	城投控股	2,300	9,844.00	0.00
336	600266	城建发展	2,400	9,792.00	0.00
337	002019	亿帆医药	700	9,786.00	0.00
338	603650	彤程新材	300	9,774.00	0.00
339	002155	湖南黄金	800	9,712.00	0.00

340	000012	南玻 A	1,300	9,646.00	0.00
341	000581	威孚高科	500	9,625.00	0.00
342	002127	南极电商	1,800	9,612.00	0.00
343	002266	浙富控股	2,000	9,580.00	0.00
344	600648	外高桥	700	9,520.00	0.00
345	000987	越秀金控	1,350	9,490.50	0.00
346	601860	紫金银行	3,300	9,471.00	0.00
347	002124	天邦食品	1,400	9,408.00	0.00
348	600968	海油发展	3,600	9,288.00	0.00
349	000883	湖北能源	1,800	9,198.00	0.00
350	002939	长城证券	900	9,144.00	0.00
351	600787	中储股份	1,600	9,104.00	0.00
352	000686	东北证券	1,300	9,087.00	0.00
353	000930	中粮科技	1,000	9,040.00	0.00
353	000709	河钢股份	4,000	9,040.00	0.00
355	002595	豪迈科技	400	8,936.00	0.00
356	300376	易事特	1,100	8,932.00	0.00
357	002153	石基信息	560	8,887.20	0.00
358	002831	裕同科技	300	8,865.00	0.00
359	002701	奥瑞金	1,700	8,840.00	0.00
360	600928	西安银行	2,400	8,808.00	0.00
361	688289	圣湘生物	296	8,764.56	0.00
362	002511	中顺洁柔	700	8,764.00	0.00
363	000690	宝新能源	2,000	8,760.00	0.00
364	000598	兴蓉环境	1,700	8,687.00	0.00
365	300315	掌趣科技	2,600	8,684.00	0.00
366	600339	中油工程	3,000	8,670.00	0.00
367	002958	青农商行	2,600	8,632.00	0.00
368	600729	重庆百货	400	8,628.00	0.00
369	000656	金科股份	3,000	8,580.00	0.00
370	002002	鸿达兴业	2,300	8,533.00	0.00
371	002532	天山铝业	1,300	8,489.00	0.00
372	002690	美亚光电	390	8,455.20	0.00
373	002004	华邦健康	1,500	8,370.00	0.00
374	002396	星网锐捷	368	8,331.52	0.00
375	600623	华谊集团	1,000	8,300.00	0.00
376	000090	天健集团	1,200	8,268.00	0.00
377	300115	长盈精密	800	8,248.00	0.00
378	600835	上海机电	600	8,238.00	0.00
379	600556	天下秀	1,000	8,230.00	0.00
380	300463	迈克生物	400	8,196.00	0.00
381	600639	浦东金桥	600	8,154.00	0.00
382	601228	广州港	2,200	8,074.00	0.00

383	002048	宁波华翔	500	8,010.00	0.00
384	002745	木林森	800	7,816.00	0.00
385	000089	深圳机场	1,000	7,720.00	0.00
386	600377	宁沪高速	900	7,713.00	0.00
387	002075	沙钢股份	1,600	7,696.00	0.00
388	600095	湘财股份	1,000	7,690.00	0.00
389	002368	太极股份	400	7,684.00	0.00
390	002985	北摩高科	130	7,615.40	0.00
391	002390	信邦制药	1,100	7,601.00	0.00
392	603868	飞科电器	100	7,575.00	0.00
393	000540	中天金融	3,900	7,527.00	0.00
394	002085	万丰奥威	1,400	7,518.00	0.00
395	000937	冀中能源	1,000	7,460.00	0.00
396	300166	东方国信	800	7,376.00	0.00
397	002440	闰土股份	900	7,254.00	0.00
398	001914	招商积余	400	7,188.00	0.00
399	002468	申通快递	600	7,152.00	0.00
400	000559	万向钱潮	1,200	7,128.00	0.00
401	000898	鞍钢股份	2,200	7,084.00	0.00
402	002233	塔牌集团	800	7,080.00	0.00
403	002010	传化智联	1,100	7,073.00	0.00
404	002281	光迅科技	400	7,032.00	0.00
405	300630	普利制药	200	7,030.00	0.00
406	300212	易华录	400	6,960.00	0.00
407	601139	深圳燃气	1,000	6,940.00	0.00
408	002174	游族网络	700	6,839.00	0.00
409	600871	石化油服	3,600	6,804.00	0.00
410	002038	双鹭药业	700	6,797.00	0.00
411	603056	德邦股份	500	6,715.00	0.00
412	600299	安迪苏	700	6,706.00	0.00
413	002110	三钢闽光	1,100	6,699.00	0.00
414	002382	蓝帆医疗	700	6,685.00	0.00
415	603379	三美股份	300	6,675.00	0.00
416	003022	联泓新科	200	6,646.00	0.00
417	002705	新宝股份	300	6,597.00	0.00
418	300072	三聚环保	1,300	6,578.00	0.00
419	000990	诚志股份	600	6,570.00	0.00
420	601298	青岛港	1,200	6,564.00	0.00
421	000402	金融街	1,100	6,545.00	0.00
422	002429	兆驰股份	1,700	6,528.00	0.00
423	002416	爱施德	700	6,510.00	0.00
424	000537	广宇发展	500	6,495.00	0.00
425	002925	盈趣科技	300	6,456.00	0.00

426	688088	虹软科技	200	6,318.00	0.00
427	000758	中色股份	1,300	6,279.00	0.00
428	002867	周大生	400	6,212.00	0.00
429	000488	晨鸣纸业	1,100	6,204.00	0.00
430	601869	长飞光纤	200	6,184.00	0.00
431	603786	科博达	100	6,157.00	0.00
432	000877	天山股份	500	6,150.00	0.00
433	000685	中山公用	800	6,144.00	0.00
434	001965	招商公路	800	6,104.00	0.00
435	002081	金螳螂	1,200	6,096.00	0.00
436	002146	荣盛发展	2,000	6,060.00	0.00
437	300271	华宇软件	800	6,016.00	0.00
438	601969	海南矿业	700	6,013.00	0.00
439	000158	常山北明	1,000	6,000.00	0.00
440	300257	开山股份	400	5,984.00	0.00
441	600823	世茂股份	2,000	5,960.00	0.00
442	601156	东航物流	300	5,940.00	0.00
443	000528	柳工	900	5,859.00	0.00
444	600350	山东高速	1,100	5,775.00	0.00
445	603708	家家悦	400	5,696.00	0.00
446	002458	益生股份	600	5,622.00	0.00
447	000563	陕国投 A	1,800	5,616.00	0.00
448	002242	九阳股份	300	5,508.00	0.00
449	000961	中南建设	1,800	5,490.00	0.00
450	300133	华策影视	1,100	5,478.00	0.00
451	002424	贵州百灵	700	5,383.00	0.00
452	002387	维信诺	800	5,376.00	0.00
453	002399	海普瑞	300	5,274.00	0.00
454	000959	首钢股份	1,100	5,236.00	0.00
455	603515	欧普照明	300	5,235.00	0.00
456	000718	苏宁环球	1,400	5,152.00	0.00
457	002434	万里扬	600	5,130.00	0.00
458	603355	莱克电气	200	5,046.00	0.00
459	000671	阳光城	2,300	5,037.00	0.00
460	000415	渤海租赁	2,300	4,991.00	0.00
461	601568	北元集团	770	4,881.80	0.00
462	601828	美凯龙	800	4,848.00	0.00
463	000553	安道麦 A	400	4,844.00	0.00
464	000031	大悦城	1,200	4,800.00	0.00
465	002563	森马服饰	800	4,736.00	0.00
466	002945	华林证券	300	4,575.00	0.00
467	000967	盈峰环境	900	4,554.00	0.00
468	600466	蓝光发展	2,700	4,509.00	0.00



469	003035	南网能源	700	4,445.00	0.00
470	601665	齐鲁银行	900	4,392.00	0.00
471	600917	重庆燃气	600	4,332.00	0.00
472	002423	中粮资本	600	4,026.00	0.00
473	000156	华数传媒	500	3,985.00	0.00
474	002302	西部建设	500	3,880.00	0.00
475	000717	韶钢松山	1,100	3,850.00	0.00
476	002815	崇达技术	300	3,843.00	0.00
477	000062	深圳华强	300	3,810.00	0.00
478	600956	新天绿能	300	3,696.00	0.00
479	601003	柳钢股份	900	3,645.00	0.00
480	002948	青岛银行	1,000	3,620.00	0.00
481	002653	海思科	200	3,222.00	0.00
482	001872	招商港口	200	3,120.00	0.00
483	600903	贵州燃气	400	3,116.00	0.00
484	002375	亚厦股份	600	3,006.00	0.00
485	601187	厦门银行	500	2,980.00	0.00
486	000028	国药一致	100	2,979.00	0.00
487	000869	张裕 A	100	2,974.00	0.00
488	000046	泛海控股	1,900	2,888.00	0.00
489	603719	良品铺子	100	2,863.00	0.00
490	300869	康泰医学	100	2,826.00	0.00
491	300741	华宝股份	100	2,782.00	0.00
492	603983	丸美股份	100	2,680.00	0.00
493	002946	新乳业	200	2,598.00	0.00
494	600006	东风汽车	300	2,265.00	0.00
495	001203	大中矿业	200	2,260.00	0.00

## 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

## 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600522	中天科技	124,376.00	0.00
2	600256	广汇能源	120,366.00	0.00
3	600157	永泰能源	96,088.00	0.00
4	601615	明阳智能	94,026.00	0.00
5	600188	兖矿能源	91,025.00	0.00
6	688099	晶晨股份	88,451.18	0.00
7	688005	容百科技	88,077.32	0.00
8	601117	中国化学	76,604.00	0.00
9	600141	兴发集团	71,798.00	0.00
10	603613	国联股份	71,733.00	0.00

11	601555	东吴证券	70,602.00	0.00
12	600563	法拉电子	70,509.00	0.00
13	600765	中航重机	70,063.00	0.00
14	600884	杉杉股份	67,987.00	0.00
15	600233	圆通速递	67,218.00	0.00
16	601689	拓普集团	67,073.00	0.00
17	600486	扬农化工	66,942.00	0.00
18	600399	抚顺特钢	65,905.00	0.00
19	600885	宏发股份	65,069.00	0.00
20	600392	盛和资源	64,422.00	0.00

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

本基金本报告期无股票卖出。

#### 7.5.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	10,222,496.10
卖出股票收入（成交）总额	-

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	500.09	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	500.09	0.00

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	------	--------------

1	127064	杭氧转债	5	500.09	0.00
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.11 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型联接基金，主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股和备选成份股。本基金根据基金合同规定投资股指期货旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	8,645,638.76
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,876,568.83
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,522,207.59

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华夏中证 500ETF 联接 A	171,075	19,129.86	857,298,080.19	26.20%	2,415,343,157.17	73.80%
华夏中证 500ETF 联接 C	13,893	11,228.96	52,027,273.98	33.35%	103,976,655.70	66.65%
合计	184,968	18,536.42	909,325,354.17	26.52%	2,519,319,812.87	73.48%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华夏中证 500ETF 联接 A	493,596.28	0.02%
	华夏中证 500ETF 联接 C	100,713.52	0.06%
	合计	594,309.80	0.02%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	华夏中证 500ETF 联接 A	0~10
	华夏中证 500ETF 联接 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本	华夏中证 500ETF 联接 A	0

开放式基金	华夏中证 500ETF 联接 C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏中证 500ETF 联接 A	华夏中证 500ETF 联接 C
基金合同生效日（2015 年 5 月 5 日）基金份额总额	1,639,232,278.45	-
本报告期期初基金份额总额	3,096,756,612.78	284,245,125.20
本报告期基金总申购份额	456,634,180.89	153,937,494.13
减：本报告期基金总赎回份额	280,749,556.31	282,178,689.65
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,272,641,237.36	156,003,929.68

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，桂勇先生担任华夏基金管理有限公司首席信息官，李一梅女士不再兼任。华夏基金管理有限公司已根据法律法规的规定完成财务负责人孙立强先生的有关备案工作。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	3	7,751,004.30	75.82%	3,343.40	75.82%	-
方正证券	1	2,471,491.80	24.18%	1,065.99	24.18%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范。

ii 公司财务状况良好。

iii有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv有较强的全方位金融服务能力和水平：能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③除本表列示外，本基金还选择了海通证券、中金公司的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信证券	-	-	-	-	-	-	295,629,001.70	100.00%

方正 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
----------	---	---	---	---	---	---	---	---

#### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-24
2	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-25

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
- 3、《华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二二年八月三十日